

金盛证券投资基金季度报告

2006年第1季度

一、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年4月14日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

二、基金产品概况

1、基金简介

基金简称：基金金盛

交易代码：184703

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2000年4月26日

报告期末基金份额总额：500,000,000份

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

2、基金产品说明

(1) 投资目标：本基金是以涉及新兴产业的上市公司为投资重点的成长型基金；所追求的投资目标是在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。

(2) 投资策略：根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据利率的走势和通货膨胀预期决定本基金的债券投资比例；根据国家的产业政策以及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司的价值分析和其在行业中的竞争优势分析选择所要投资的股票。

本基金在行业资产配置中坚持相对集中的投资策略，挖掘具有良好发展态势的行业，将资产权重的大部分配置到处于起步或成长阶段的行业。

(3) 业绩比较基准：无。

(4) 风险收益特征：承担较高风险，获取较高的超额收益。

三、主要财务指标和基金净值表现（未经审计）

1、各主要财务指标

	2006年1-3月
基金本期净收益	23,652,355.81 元
基金份额本期净收益	0.0473 元
期末基金资产净值	610,092,563.74 元
期末基金份额净值	1.2202 元

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、基金金盛净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.15%	1.35%	-	-	-	-

注：本基金根据基金合同无业绩比较基准。

3、基金金盛累计净值增长率历史走势图



四、基金管理人报告

1、基金管理合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

报告期内本基金未发生任何损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障了投资人的合法权益。

2、基金经理介绍

王雄辉，男，经济学硕士，9年证券从业经历。曾任南开大学教师，国泰基金管理有限公司研究开发部行业研究员，金泰基金基金经理助理，金泰基金基金经理，投资决策委员会秘书，理财部投资经理。

3、本基金的投资策略和业绩表现说明

(1) 2006年第一季度证券市场与投资管理回顾

如大多数机构投资者所料，2006年一季度A股市场延续去年底的涨势一举升至1300点附近并蓄势盘整，股改持续推进带来的赚钱效应、人民币持续升值带来的地产等行业的资产升值、以及国际经济宽松货币环境下的商品价格上涨是支撑市场强势的三个最主要因素。

本基金对股改效应和强势商品两方面的影响较早就有所认识，而且在本季度对地产行业的配置上又有所加强，股票组合主体基本契合了市场方向，也获得了较好的回报。不足之处在于在一个强势市场中对于强势品种的集中度不够，总体表现不算突出。

(2) 2006年第二季度市场及投资管理展望

人民币资产升值和强势商品基本上可以看作一种货币现象，这一现象在今后仍将持续。二季度股改基本上进入尾声，股改带来的估值水平的下降目前看来也仍然存在。在此二者前提下，市场仍将处于向好的格局中，对于扩容的担心也显得过多，但货币政策的变化和在新老划断之前市场上涨的程度，会让前提有所改变，也必然会带来市场的振荡和格局变化。

五、基金投资组合报告

1、基金资产组合情况

分 类	市值(元)	占总资产比例
股票	478,788,180.69	76.97%
债券	125,614,079.13	20.19%
权证	944,526.87	0.15%
银行存款及清算备付金	14,274,751.67	2.29%
其他资产	2,438,224.71	0.39%
合 计	622,059,763.07	100.00%

2、按行业分类的股票投资组合

序号	分 类	市 值(元)	占净值比例
1	农、林、牧、渔业	15,010,359.13	2.46%
2	采掘业	27,350,041.60	4.48%
3	制造业	203,334,586.96	33.33%
	其中：食品、饮料	71,919,934.76	11.79%
	石油、化学、塑胶、塑料	9,942,000.00	1.63%
	金属、非金属	56,785,000.00	9.31%
	机械、设备、仪表	37,869,952.20	6.21%
	医药、生物制品	26,817,700.00	4.40%
4	电力、煤气及水的生产和供应业	3,210,000.00	0.53%
5	建筑业	18,511,200.00	3.03%
6	交通运输、仓储业	30,211,491.00	4.95%
7	信息技术业	56,546,590.00	9.27%
8	批发和零售贸易	29,619,476.64	4.85%
9	金融、保险业	40,752,242.96	6.68%
10	房地产业	37,426,192.40	6.13%
11	社会服务业	2,120,000.00	0.35%
12	传播与文化产业	14,696,000.00	2.41%
13	综合类	-	-
	合 计	478,788,180.69	78.48%

3、按市值占基金资产净值比例的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000895	双汇发展	2,241,540	40,616,704.80	6.66%
2	600036	G招行	5,401,276	34,892,242.96	5.72%
3	000060	G中金	2,900,000	32,828,000.00	5.38%
4	600406	国电南瑞	1,462,900	27,941,390.00	4.58%
5	000538	云南白药	890,000	24,145,700.00	3.96%
6	600519	贵州茅台	350,000	20,765,500.00	3.40%
7	000063	G中兴	670,000	20,475,200.00	3.36%
8	600031	G三一	2,822,274	20,094,590.88	3.29%
9	600694	大商股份	803,712	19,264,976.64	3.16%
10	600970	中材国际	1,080,000	18,511,200.00	3.03%

4、按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国家债券	105,318,079.13	17.26%
2	金融债券	20,296,000.00	3.33%
	合计	125,614,079.13	20.59%

5、按市值占基金资产净值比例的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	银行间00国债12	41,453,333.33	6.79%
2	02国债(14)	31,274,160.00	5.13%
3	05农发04	20,296,000.00	3.33%
4	02国债(10)	9,574,297.60	1.57%
5	21国债(3)	9,142,200.00	1.50%

6、报告附注

- (1) 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。
- (2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。
- (3) 其他资产的构成如下：

分 类	市值(元)
交易保证金	390,741.00
应收股利	99,000.00
应收利息	1,948,483.71
合 计	2,438,224.71

- (4) 报告期末本基金无处于转股期的可转换债券。

(5) 本报告期内投资权证明细如下：

a、因股权分置改革被动持有

权证代码	权证名称	配售日期	配售数量(份)	成本(元)
580997	招行CMP1	2006/2/27	2,286,990	0.00
580996	沪场JTP1	2006/3/2	525,000	0.00
合计			2,811,990	0.00

b、本报告期内无主动投资的权证。

六、本基金管理人运用固有资金投资本基金情况

截止本报告期末，本基金管理人运用固有资金投资本基金的基金份额为2,307,692份，系本基金扩募时本基金管理人作为基金发起人认购的份额。报告期内所持有的基金份额无变动。

七、备查文件目录

- 1、关于同意设立金盛证券投资基金的批复
- 2、金盛证券投资基金合同
- 3、金盛证券投资基金托管协议
- 4、金盛证券投资基金各年度半年度报告、年度报告及收益分配报告
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、国泰基金管理有限公司营业执照和公司章程

备查文件存放地点：本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市延安东路700号港泰广场22-23楼

投资者查阅方式：可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 33134688, 400-8888-688

客户投诉电话：(021) 23060279

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

2006年4月19日